BANK OF CANADA
BANQUE DU CANADA

WEEKLY FINANCIAL STATISTICS

BULLETIN HEBDOMADAIRE DE STATISTIQUES FINANCIÈRES

FOR IMMEDIATE RELEASE
POUR PUBLICATION IMMÉDIATE

February 3, 2017
Le 3 février 2017

CONTENTS
TABLE DES MATIÈRES

Page *Page*		Table[1] *Tableau*[1]
3	Bank of Canada: assets and liabilities / *Banque du Canada : actif et passif*	B2
* 3	Positions of members of the Payments Canada with the Bank of Canada[2] / *Positions des membres de Paiements Canada à la Banque du Canada*[2]	B3
* 4	Bank of Canada special purchase and resale agreements/sale and repurchase agreements intervention, and other Bank of Canada operations / *Intervention de la Banque du Canada dans le cadre de prises en pension spéciales ou de cessions en pension, et autres opérations de la Banque du Canada*	B3
* 5, 6, 7	Financial market statistics / *Statistiques du marché financier*	F1
* 7	Exchange rates / *Cours du change*	I1
* 8	Government of Canada securities outstanding / *Encours des titres du gouvernement canadien*	G4
* 8	Government of Canada deposits / *Dépôts du gouvernement canadien*	
* 9, 10	Charts: interest rates, exchange rates and monetary conditions indicators *Graphiques : taux d'intérêt, cours du change et indicateurs des conditions monétaires*	
* 11	Consumer Price Index and monetary conditions indicators *Indice des prix à la consommation et indicateurs des conditions monétaires*	

Data in this package are unadjusted unless otherwise stated. / *À moins d'indication contraire, les données de cette publication n'ont pas été désaisonnalisées.*

For all Wednesday series, in the event a holiday falls on a Wednesday, data for the preceding business day will be shown. / *Si un jour férié tombe un mercredi, ce sont les séries du jour ouvrable précédent qui sont présentées.*

"R" revised / *révisé*
"E" estimate / *estimation*
"NA" not available / *non disponible*
"P" preliminary / *préliminaire*
* New information this week. / *Nouvelles données de cette semaine*

(1) Refers to the corresponding Bank of Canada Banking and Financial Statistics tables and footnotes. / *Renvoie à la note ou au tableau correspondant dans les Statistiques bancaires et financières de la Banque du Canada.*

(2) Payments Canada was formerly known as Canadian Payments Association / *Paiements Canada est le nouveau nom de l'Association canadienne des paiements.*

Note to Users (over)
Avis aux Utilisateurs (verso)

Note to Users

As of 23 December 2016, Core CPI (defined as the all-items CPI that excludes eight of the most volatile components as well as the effect of indirect taxes on the remaining components) was replaced by three preferred measures of core inflation; CPI-trim, CPI-median and CPI-common. The series previously known as Core CPI will continue to be published by Statistics Canada.

Avis aux Utilisateurs

À compter du 23 décembre 2016, l'indice de référence (défini comme l'IPC d'ensemble excluant huit des composantes les plus volatiles ainsi que l'effet des impôts indirects sur les autres composantes) est remplacé par trois mesures privilégiées de l'inflation fondamentale; IPC-tronq, IPC-méd et IPC-comm. La série qui était jusqu'à tout récemment l'indice de référence continuera d'être publiée par Statistique Canada.

Weekly Financial Statistics

Internet

The *Weekly Financial Statistics* publication (including a schedule for the release of data) is available on the Bank of Canada's website.

Public Information and subscriptions

For information on the contents of the *Weekly Financial Statistics*, general information or to subscribe to email alerts for this and other publications, contact our Public Information Office:

Telephone: 1 800 303-1282 (toll-free, North America)
613 782-8111 (Ottawa area, outside North America)
Fax: 613 782-7713
Email: info@bankofcanada.ca

Media Inquiries

Please direct all media inquiries to Public Affairs:
Telephone: 613 782-8782
Email: communications@bankofcanada.ca

Bulletin hebdomadaire de statistiques financières

Internet

On peut consulter le *Bulletin hebdomadaire de statistiques financières* (y compris le calendrier de publication des données) dans le site Web de la Banque du Canada.

Information publique et abonnements

Pour en savoir plus sur le contenu du *Bulletin hebdomadaire de statistiques financières*, obtenir des renseignements d'ordre général ou s'abonner au service de messagerie électronique de la Banque du Canada afin d'être avisé par courriel de la parution de ses publications, il suffit de communiquer avec le Service d'information publique:

Téléphone : 1 800 303-1282 (sans frais en Amérique du Nord)
613 782-8111 (région d'Ottawa et hors de l'Amérique du Nord)
Télécopieur : 613 782-7713
Adresse électronique : info@banqueducanada.ca

Demandes des médias

Les médias sont priés de présenter leur demandes de renseignements à l'équipe chargées des affaires publiques :
Téléphone : 613 782-8782
Adresse électronique : communications@banqueducanada.ca

Contents may be reproduced or referred to provided that the Weekly Financial Statistics with its date, is specifically quoted as the source.

Reproduction autorisée à condition que la source–Bulletin hebdomadaire de statistiques financières–et la date soient formellement indiquée.

ISSN 1487-0444

BANK OF CANADA: ASSETS AND LIABILITIES (Millions of dollars)[2,3]

BFS Table B2
SBF Tableau B2

BANQUE DU CANADA : ACTIF ET PASSIF (En millions de dollars)[2,3]

Average of Wednesdays and Wednesday *Moyenne mensuelle des mercredis ou données du mercredi*	Assets *Actif*					Total assets or liabilities and capital *Total de l'actif ou du passif et capital*	Liabilities and capital *Passif et capital*			
	Government of Canada direct and guaranteed securities *Titres émis ou garantis par le gouvernement canadien*		Advances *Avances*	Securities purchased under resale agreements[1] *Titres achetés dans le cadre de conventions de revente*[1]	All other assets *Autres éléments de l'actif*		Notes in Circulation *Billets en circulation*	Canadian dollars deposits *Dépôts en dollars canadiens*		All other liabilities and capital *Autres éléments du passif et capital*
	Treasury bills *Bons du Trésor*	Total bonds *Total des obligations*						Government of Canada *Gouvernement canadien*	Members of the Payments Canada[4] *Membres de Paiements Canada*[4]	
	V36598	V36599	V36648	V44201361	V36649	V36596	V36639	V36642	V36650	V36646
	V36612	V36613	V36634	V44201362	V36635	V36610	V36625	V36628	V36636	V36632
2016 A	18,637	76,285	-	7,300	1,007	103,229	76,600	23,474	492	2,662
S	18,960	76,386	-	7,000	1,012	103,358	76,790	23,337	430	2,801
O	18,331	77,775	14	7,002	1,016	104,138	77,192	23,570	515	2,862
N	17,106	78,139	-	7,003	1,035	103,282	77,498	22,296	475	3,013
D	16,706	79,355	2	7,602	1,046	104,712	79,166	21,855	502	3,189
2016 N 2	18,046	77,025	-	7,001	1,025	103,097	77,355	22,538	387	2,818
9	17,096	77,637	-	7,002	1,034	102,769	77,766	21,549	500	2,955
16	17,095	78,210	-	7,003	1,035	103,343	77,312	22,297	500	3,235
23	16,645	78,747	-	7,004	1,036	103,432	77,329	22,549	500	3,054
30	16,646	79,074	-	7,002	1,047	103,769	77,727	22,549	489	3,005
D 7	16,569	79,167	-	6,927	1,037	103,700	78,043	22,155	500	3,002
14	16,570	79,195	-	6,951	1,043	103,760	78,407	21,659	500	3,194
21	16,843	79,224	10	8,252	1,051	105,380	79,593	21,953	509	3,324
28	16,844	79,834	-	8,277	1,052	106,006	80,619	21,653	500	3,234
Changes from the date indicated: / *Variations par rapport à la date indiquée* :										
2015 D 30	-2,452	4,075	-	1,688	18	3,327	4,693	-1,534	-571	739
2016 D 21	1	610	-10	25	1	626	1,026	-300	-9	-90

BANK OF CANADA (Millions of dollars)[2,3]

BFS Table B3
SBF Tableau B3

BANQUE DU CANADA (En millions de dollars)[2,3]

Monthly and week ending Wednesday *Données mensuelles et de la semaine se terminant le mercredi*	Positions of members of the Payments Canada with the Bank of Canada[4] *Positions des membres de Paiements Canada à la Banque du Canada*[4]					
	Total overdraft loans *Total des prêts pour découvert*		Total positive balances *Total soldes créditeurs*		Special deposit accounts *Comptes spéciaux de dépôt*	
	Total amount *Montant total*	Days transacted *Nombre de jours*	Total amount *Montant total*	Days transacted *Nombre de jours*	Total amount *Montant total*	Days transacted *Nombre de jours*
	V41838377	V41838378	V41838379	V41838380	V41838381	V41838382
	V41838391	V41838392	V41838393	V41838394	V41838395	V41838396
2016 S	270	2	11,734	21	-	-
O	58	1	10,058	20	-	-
N	196	2	10,572	21	-	-
D	935	4	12,267	21	-	-
2017 J	-	-	10,753	21	-	-
2016 D 7	-	-	3,005	5	-	-
14	785	1	3,286	5	-	-
21	10	1	3,336	5	-	-
28	83	1	1,583	3	-	-
2017 J 4	57	1	2,307	4	-	-
11	-	-	2,502	5	-	-
18	-	-	2,500	5	-	-
25	-	-	2,500	5	-	-
F 1	11	1	2,513	5	-	-

(1) Includes Overnight Repo and Term Repo Operations / *Comprend les prises en pension à un jour et les prises en pension à plus d'un jour.*

(2) Information to update these tables may not be available at time of publishing. / *Il se peut que l'information nécessaire à la mise à jour de ces tableaux ne soit pas disponible au moment de la publication.*

(3) In the event that an Emergency Lending Assistance (ELA) advance is made, the advance will not be included in the Weekly Financial Statistics until public disclosures have otherwise occurred. Any outstanding ELA advances are included in the Bank's monthly balance sheet and its annual and quarterly financial statements. Additional information on the Bank's ELA operations can be found at: http://www.bankofcanada.ca/core-functions/financial-system/lender-of-last-resort. The Weekly Financial Statistics will not be restated after ELA has been otherwise disclosed. / *L'octroi d'une aide d'urgence n'est pas inclus dans le Bulletin hebdomadaire de statistiques financières si l'opération n'a pas encore été divulguée autrement au public. Toute avance en cours au titre de l'aide d'urgence est inscrite dans le bilan mensuel ainsi que dans les états financiers annuels et trimestriels de la Banque. Pour obtenir des renseignements supplémentaires sur les activités de l'institution relatives à l'octroi d'une aide d'urgence, consultez le site : http://www.banqueducanada.ca/grandes-fonctions/systeme-financier/prets-de-dernier-ressort. Le Bulletin hebdomadaire de statistiques financières n'est pas remanié après la divulgation de l'octroi d'une aide d'urgence.*

(4) Payments Canada was formerly known as Canadian Payments Association / *Paiements Canada est le nouveau nom de l'Association canadienne des paiements.*

continued
suite

BANK OF CANADA (Millions of dollars)[2,3]

BANQUE DU CANADA (En millions de dollars)[2,3]

Monthly and week ending Wednesday *Données mensuelles et de la semaine se terminant le mercredi*			Bank of Canada special purchase and resale agreements/sale and repurchase agreements intervention *Intervention de la Banque du Canada dans le cadre de prises en pension spéciales ou de cessions en pension*				Other Bank of Canada operations *Autres opérations de la Banque du Canada*			
			Overnight Repo[1] *Prises en pension à un jour*[1]		Sale and repurchase agreements *Cessions en pension*		Term Repo Operations[4] *Prises en pension à plus d'un jour*		Securities lending operations *Opérations de prêt de titres*	
			Total amount *Montant total*	Days transacted *Nombre de jours*	Total amount *Montant total*	Days transacted *Nombre de jours*	Total amount *Montant total*	Days transacted *Nombre de jours*	Total amount *Montant total*	Days transacted *Nombre de jours*
			V41838383 V41838397	V41838384 V41838398	V41838385 V41838399	V41838386 V41838400	V41838387 V41838401	V41838388 V41838402	V41838389 V41838403	V41838390 V41838404
2016	S		1,500	1	-	-	8,000	3	812	6
	O		-	-	-	-	5,000	2	10	1
	N		-	-	-	-	5,000	2	-	-
	D		3,000	2	1,500	1	6,300	3	63	1
2017	J		1,500	1	1,500	1	5,000	2	-	-
2016	D	7	1,500	1	-	-	-	-	63	1
		14	-	-	-	-	2,000	1	-	-
		21	1,500	1	-	-	1,300	1	-	-
		28	-	-	-	-	3,000	1	-	-
2017	J	4	1,500	1	1,500	1	-	-	-	-
		11	-	-	1,500	1	2,000	1	-	-
		18	-	-	-	-	-	-	-	-
		25	-	-	-	-	3,000	1	-	-
	F	1	-	-	-	-	-	-	-	-

(1) Formerly called "Special purchase and resale agreements" / Auparavant appelées « Prises en pension spéciales ».

(2) Information to update these tables may not be available at time of publishing. / *Il se peut que l'information nécessaire à la mise à jour de ces tableaux ne soit pas disponible au moment de la publication.*

(3) In the event that an Emergency Lending Assistance (ELA) advance is made, the advance will not be included in the Weekly Financial Statistics until public disclosures have otherwise occurred. Any outstanding ELA advances are included in the Bank's monthly balance sheet and its annual and quarterly financial statements. Additional information on the Bank's ELA operations can be found at: http://www.bankofcanada.ca/core-functions/financial-system/lender-of-last-resort. The Weekly Financial Statistics will not be restated after ELA has been otherwise disclosed. / *L'octroi d'une aide d'urgence n'est pas inclus dans le Bulletin hebdomadaire de statistiques financières si l'opération n'a pas encore été divulguée autrement au public. Toute avance en cours au titre de l'aide d'urgence est inscrite dans le bilan mensuel ainsi que dans les états financiers annuels et trimestriels de la Banque. Pour obtenir des renseignements supplémentaires sur les activités de l'institution relatives à l'octroi d'une aide d'urgence, consultez le site : http://www.banqueducanada.ca/grandes-fonctions/systeme-financier/prets-de-dernier-ressort. Le Bulletin hebdomadaire de statistiques financières n'est pas remanié après la divulgation de l'octroi d'une aide d'urgence.*

(4) Formerly called "Term purchase and resale".

FINANCIAL MARKET STATISTICS
STATISTIQUES DU MARCHÉ FINANCIER

BFS Table F1
SBF Tableau F1

Effective date (year, month, day) *Date d'entrée en vigueur (année, mois, jour)*	Bank Rate *Taux officiel d'escompte*	Operating band *Fourchette opérationnelle* Low *Bas*	High *Haut*	Target overnight rate *Taux cible du financement à un jour*
	V39078	V39076	V39077	V39079
2008 3 04	3.75	3.25	3.75	3.50
4 22	3.25	2.75	3.25	3.00
10 08	2.75	2.25	2.75	2.50
21	2.50	2.00	2.50	2.25
12 09	1.75	1.25	1.75	1.50
2009 1 20	1.25	0.75	1.25	1.00
3 03	0.75	0.25	0.75	0.50
4 21	0.50	0.25	0.50	0.25
2010 6 01	0.75	0.25	0.75	0.50
7 20	1.00	0.50	1.00	0.75
9 08	1.25	0.75	1.25	1.00
2015 1 21	1.00	0.50	1.00	0.75
7 15	0.75	0.25	0.75	0.50

Wednesday *Le mercredi*	Chartered bank administered interest rates *Taux d'intérêt administrés des banques à charte* Prime business *Taux de base des prêts aux entreprises*	Conventional mortgage *Prêts hypothécaires ordinaires* 1 year *À 1 an*	5 year *À 5 ans*	Non-chequable savings deposits *Dépôts d'épargne non transférables par chèque*	Daily interest savings (balances over $100,000) *Comptes d'épargne à intérêt quotidien (soldes supérieurs à 100 000 $)*	5-year personal fixed term *Dépôts à 5 ans des particuliers*	Guaranteed investment certificates *Certificats de placement garantis* 1 year *À 1 an*	5 year *À 5 ans*
	v80691311	v80691333	v80691335	v80691338	v80691337	v80691336	v80691339	v80691341
2016 O 26	2.70	3.14	4.64	0.05	0.05	1.15	0.73	1.45
N 2	2.70	3.14	4.64	0.05	0.05	1.15	0.73	1.45
9	2.70	3.14	4.64	0.05	0.05	1.15	0.73	1.45
16	2.70	3.14	4.64	0.05	0.05	1.15	0.73	1.45
23	2.70	3.14	4.64	0.05	0.05	1.15	0.73	1.45
30	2.70	3.14	4.64	0.05	0.05	1.15	0.73	1.45
D 7	2.70	3.14	4.64	0.05	0.05	1.15	0.73	1.45
14	2.70	3.14	4.64	0.05	0.05	1.15	0.73	1.45
21	2.70	3.14	4.64	0.05	0.05	1.15	0.73	1.45
28	2.70	3.14	4.64	0.05	0.05	1.15	0.73	1.45
2017 J 4	2.70	3.14	4.64	0.05	0.05	1.15	0.73	1.45
11	2.70	3.14	4.64	0.05	0.05	1.15	0.73	1.45
18	2.70	3.14	4.64	0.05	0.05	1.15	0.73	1.45
25	2.70	3.14	4.64	0.05	0.05	1.15	0.73	1.45
F 1	2.70	3.14	4.64	0.05	0.05	1.15	0.73	1.45

FINANCIAL MARKET STATISTICS
STATISTIQUES DU MARCHÉ FINANCIER

continued
suite

Wednesday and latest week *Le mercredi et la dernière semaine*	Treasury bills *Bons du Trésor* 1 month *À 1 mois*	3 month *À 3 mois*	6 month *À 6 mois*	1 year *À 1 an*	Selected Government of Canada benchmark bond yields *Quelques rendements d'obligations types du gouvernement canadien* 2 year *À 2 ans*	3 year *À 3 ans*	5 year *À 5 ans*	7 year *À 7 ans*	10 year *À 10 ans*	long-term *À long terme*	Real Return Bonds, long-term *Obligations à long terme à rendement réel*	Government of Canada marketable bonds, average yield *Rendements moyens des obligations négociables du gouvernement canadien* 1-3 year *De 1 à 3 ans*	3-5 year *De 3 à 5 ans*	5-10 year *De 5 à 10 ans*	Over 10 years *De plus de 10 ans*
	v80691342	v80691344	v80691345	v80691346	v80691322	v80691323	v80691324	v80691325	v80691326	v80691327	v80691347	v80691328	v80691329	v80691330	v80691331
	V39063	V39065	V39066	V39067	V39051	V39052	V39053	V39054	V39055	V39056	V39057	V39059	V39060	V39061	V39062
2016 O 26	0.47	0.49	0.51	0.55	0.56	0.57	0.68	0.86	1.15	1.82	0.25	0.56	0.62	0.94	1.68
N 2	0.45	0.47	0.49	0.53	0.54	0.56	0.68	0.88	1.18	1.83	0.22	0.54	0.62	0.96	1.69
9	0.44	0.46	0.48	0.55	0.59	0.62	0.82	1.04	1.38	2.03	0.27	0.59	0.74	1.15	1.89
16	0.43	0.49	0.54	0.58	0.66	0.72	0.94	1.19	1.50	2.12	0.35	0.66	0.85	1.26	2.00
23	0.45	0.47	0.52	0.57	0.67	0.74	0.98	1.23	1.55	2.18	0.35	0.67	0.89	1.31	2.05
30	0.47	0.51	0.55	0.59	0.70	0.75	1.00	1.27	1.58	2.16	0.35	0.69	0.92	1.35	2.06
D 7	0.42	0.46	0.53	0.58	0.70	0.76	0.99	1.27	1.59	2.21	0.43	0.69	0.91	1.35	2.10
14	0.43	0.49	0.56	0.62	0.80	0.88	1.16	1.47	1.78	2.38	0.64	0.79	1.07	1.54	2.28
21	0.42	0.48	0.56	0.62	0.83	0.92	1.21	1.49	1.81	2.40	0.65	0.81	1.12	1.57	2.30
28	0.42	0.48	0.57	0.64	0.78	0.87	1.16	1.43	1.73	2.34	0.58	0.76	1.06	1.50	2.24
2017 J 4	0.39	0.45	0.55	0.62	0.75	0.84	1.11	1.40	1.71	2.30	0.49	0.74	1.03	1.47	2.20
11	0.40	0.47	0.52	0.63	0.75	0.83	1.09	1.37	1.68	2.28	0.50	0.73	1.01	1.44	2.18
18	0.41	0.43	0.50	0.61	0.76	0.82	1.10	1.38	1.70	2.32	0.55	0.72	1.01	1.45	2.21
25	0.42	0.45	0.49	0.62	0.82	0.99	1.17	1.46	1.82	2.45	0.70	0.76	1.08	1.55	2.34
F 1	0.46	0.47	0.50	0.60	0.77	0.93	1.11	1.40	1.76	2.41	0.65	0.72	1.02	1.49	2.30
2017 J 26	0.41	0.43	0.49	0.61	0.81	0.99	1.16	1.45	1.81	2.45	0.69	0.76	1.08	1.54	2.34
27	0.44	0.45	0.49	0.60	0.80	0.97	1.14	1.42	1.78	2.43	0.66	0.75	1.05	1.51	2.31
30	0.45	0.46	0.50	0.61	0.79	0.95	1.14	1.43	1.78	2.43	0.67	0.74	1.06	1.51	2.32
31	0.45	0.46	0.51	0.59	0.77	0.92	1.11	1.39	1.75	2.41	0.64	0.72	1.01	1.48	2.29
F 1	0.46	0.47	0.50	0.60	0.77	0.93	1.11	1.40	1.76	2.41	0.65	0.72	1.02	1.49	2.30

FINANCIAL MARKET STATISTICS

STATISTIQUES DU MARCHÉ FINANCIER

continued
suite

Wednesday and latest week *Le mercredi et la dernière semaine*			Bankers' acceptances *Acceptations bancaires* 1 month *À 1 mois*	3 month *À 3 mois*	Prime corporate paper rate *Taux du papier de premier choix des sociétés non financières* 1 month *À 1 mois*	3 month *À 3 mois*
			v80691318 V39068	v80691320 V39071	v80691315 V39072	v80691317 V39074
2016	O	26	0.81	0.84	0.81	0.82
	N	2	0.81	0.84	0.81	0.82
		9	0.80	0.83	0.81	0.82
		16	0.81	0.83	0.81	0.82
		23	0.80	0.83	0.81	0.82
		30	0.80	0.83	0.81	0.82
	D	7	0.82	0.84	0.81	0.82
		14	0.87	0.86	0.81	0.82
		21	0.87	0.87	0.82	0.82
		28	0.89	0.89	0.84	0.84
2017	J	4	0.89	0.90	0.84	0.84
		11	0.90	0.90	0.86	0.88
		18	0.90	0.91	0.86	0.88
		25	0.89	0.91	0.86	0.88
	F	1	0.89	0.91	0.86	0.88
2017	J	26	0.89	0.91	0.86	0.88
		27	0.89	0.91	0.86	0.88
		30	0.89	0.91	0.86	0.88
		31	0.90	0.91	0.86	0.88
	F	1	0.89	0.91	0.86	0.88

Tuesday (effective date in brackets) *Le mardi (date d'entrée en vigueur entre parenthèses)*			Treasury bill auction *Adjudication de bons du Trésor* Average yields *Rendement moyen* 3 month *À 3 mois*	6 month *À 6 mois*	1 year *À 1 an*	Amount auctioned *Montant adjugé* 3 month *À 3 mois*	6 month *À 6 mois*	1 year *À 1 an*	Amount maturing *Montant arrivant à échéance*
			v80691303	v80691304	v80691305	v80691306	v80691307	v80691308	v80691309
2016	O	25							
	N	1	0.472	0.507	0.541	5,300	2,100	2,100	15,700
		8							
		15	0.502	0.537	0.587	6,200	2,400	2,400	13,200
		22							
		29	0.509	0.547	0.581	7,100	2,700	2,700	13,200
	D	6							
		13	0.500	0.550	0.614	5,900	2,300	2,300	13,200
		20							
		27	0.473	0.564	0.650	5,000	2,000	2,000	10,000
2017	J	3							
		10	0.480	0.557	0.641	5,000	2,000	2,000	10,300
		17							
		24	0.456	0.527	0.609	5,000	2,000	2,000	10,200
		31							

FINANCIAL MARKET STATISTICS

STATISTIQUES DU MARCHÉ FINANCIER

continued
suite

Wednesday *Le mercredi*			Selected U.S. dollar interest rates *Quelques taux d'intérêt pratiqués aux États-Unis* Federal funds rate *Taux des fonds fédéraux*	Prime rate charged by banks *Taux de base des prêts bancaires*	Commercial paper (adjusted) *Papier commercial (taux corrigés)* 1 month *À 1 mois*	3 month *À 3 mois*	U.S. Treasuries constant maturity *Obligations du Trésor américain à échéance fixe* 5 year *À 5 ans*	10 year *À 10 ans*	Forward premium or discount (-) U.S. dollars in Canada *Report ou déport (-) sur le dollar É.-U. au Canada* 1 month *À 1 mois*	3 month *À 3 mois*
			V121821	V121820	V121822	V121823	V121826	V4429275	v80691313	v80691314
2016	O	26	0.41	3.50	0.41	0.52	1.30	1.79	-0.27	-0.30
	N	2	0.40	3.50	0.44	0.61	1.26	1.81	-0.18	-0.30
		9	0.41	3.50	0.44	0.63	1.49	2.07	-0.18	-0.30
		16	0.41	3.50	0.42	0.68	1.68	2.22	-0.27	-0.39
		23	0.41	3.50	0.41	0.68	1.83	2.36	-0.36	-0.42
		30	0.40	3.50	0.48	0.73	1.83	2.37	-0.45	-0.45
	D	7	0.41	3.50	0.55	0.73	1.80	2.34	-0.55	-0.46
		14	0.41	3.50	0.69	0.75	2.02	2.54	-0.64	-0.52
		21	0.66	3.75	0.42	0.80	2.04	2.55	-0.64	-0.48
		28	0.66	3.75	0.65	NA	2.02	2.51	-0.72	-0.51
2017	J	4	0.60	3.75	0.63	0.80	1.94	2.46	-0.37	-0.40
		11	0.66	3.75	0.65	0.80	1.89	2.38	-0.28	-0.37
		18	0.66	3.75	0.65	0.82	1.93	2.42	-0.37	-0.40
		25	0.66	3.75	0.66	0.84	1.99	2.53	-0.37	-0.40
	F	1							-0.28	-0.37

EXCHANGE RATES
COURS DU CHANGE

BFS Table I1
SBF Tableau I1

Month, week ending / *Mois ou semaine se terminant à la date indiquée*			U.S. dollar / *Dollar É.-U.* — Canadian dollars per unit / *En dollars canadiens par unité* — Spot rates / *Cours du comptant* — High / *Haut*	Low / *Bas*	Closing / *Clôture*	Average noon / *Moyenne à midi*	Canadian cents per unit / *En cents canadiens par unité* — 3-month forward spread / *Report ou déport (-) à 3 mois* — Closing / *Clôture*	Average noon / *Moyenne à midi*	Canadian dollar in U.S. funds / *Dollar canadien exprimé en dollar É.-U.* — Spot rates / *Cours du comptant* — Closing / *Clôture*	Other currencies / *Autres monnaies* — Average of noon spot rates / *Moyenne des cours du comptant à midi* — Canadian dollars per unit / *En dollars canadiens par unité* — EMU Euro / *Euro (UEM)*	British pound / *Livre sterling*	Swiss franc / *Franc suisse*	Japanese yen / *Yen japonais*	Canadian-dollar effective exchange rate index (CERI)[1] / *Indice de taux de change effectif du dollar canadien (indice TCEC)*[1] 1992 = 100
			V37433	V37434	V37432	V37426				V121742	V37430	V37429	V37456	V41498903
2016	O		1.3434	1.3005	1.3411	1.3251	-0.11	-0.09	0.7457	1.4594	1.6336	1.3417	0.012754	95.06
	N		1.3588	1.3298	1.3429	1.3438	-0.15	-0.12	0.7447	1.4486	1.6706	1.3478	0.012378	94.36
	D		1.3598	1.3081	1.3427	1.3329	-0.15	-0.16	0.7448	1.4060	1.6651	1.3080	0.011499	95.65
2017	J		1.3458	1.2969	1.3012	1.3191	-0.12	-0.13	0.7685	1.4028	1.6288	1.3091	0.011486	96.72
2017	J	4	1.3559	1.3282	1.3308	1.3412	-0.13	-0.15	0.7514	1.4058	1.6470	1.3121	0.011458	95.35
		11	1.3305	1.3119	1.3177	1.3219	-0.12	-0.12	0.7589	1.3960	1.6172	1.3018	0.011388	96.76
		18	1.3269	1.3032	1.3259	1.3133	-0.13	-0.13	0.7542	1.3991	1.6060	1.3045	0.011534	97.22
		25	1.3388	1.3062	1.3067	1.3237	-0.13	-0.14	0.7653	1.4174	1.6487	1.3202	0.011600	96.35
	F	1	1.3162	1.2969	1.3047	1.3085	-0.12	-0.13	0.7665	1.4024	1.6436	1.3137	0.011482	97.35
Latest week / *Dernière semaine* :														
2017	J	26	1.3130	1.3082	1.3098	1.3104	-0.13	-0.13	0.7635	1.3981	1.6482	1.3089	0.011420	97.33
		27	1.3143	1.3089	1.3138	1.3108	-0.13	-0.13	0.7612	1.4012	1.6424	1.3119	0.011380	97.27
		30	1.3162	1.3076	1.3120	1.3093	-0.13	-0.13	0.7622	1.3983	1.6332	1.3124	0.011500	97.30
		31	1.3084	1.2969	1.3012	1.3030	-0.12	-0.12	0.7685	1.4063	1.6396	1.3174	0.011560	97.62
	F	1	1.3102	1.3035	1.3047	1.3089	-0.12	-0.12	0.7665	1.4079	1.6548	1.3180	0.011550	97.22

(1) The Canadian-dollar effective exchange rate index (CERI) replaces the C-6 index as the Bank's new measure of the value of the Canadian dollar vis-à-vis the currencies of its most important trading partners. / *L'indice de taux de change effectif du dollar canadien (indice TCEC) s'agit du nouvel indice que la Banque utilise pour mesurer la valeur du dollar canadien par rapport aux monnaies des principaux partenaires commerciaux du Canada. L'indice TCEC remplace l'indice C-6.*

Month, week ending / *Mois ou semaine se terminant à la date indiquée*			Overnight money market financing rate / *Taux des fonds à un jour*
			V39050
2016	O		0.4944
	N		0.4853
	D		0.4914
2017	J		0.4932
2017	J	4	0.5002
		11	0.4918
		18	0.4831
		25	0.4910
	F	1	0.4954
Latest week / *Dernière semaine*			
2017	J	26	0.4939
		27	0.4936
		30	0.4784
		31	0.4932
	F	1	0.4954

End of period
En fin de période

GOVERNMENT OF CANADA SECURITIES OUTSTANDING (Par Value)
ENCOURS DES TITRES DU GOUVERNEMENT CANADIEN (Valeur nominale)

BFS Table G4
SBF Tableau G4

Millions of Canadian dollars
En millions de dollars canadiens

	Treasury bills *Bons du Trésor*	Other direct and guaranteed securities[1] *Autres titres émis ou garantis*[1]	Canada Savings Bonds and other retail instruments *Obligations d'épargne du Canada et autres titres de placements au détail*	Total *Total*	Held by *Détenteurs*						
					Bank of Canada *Banque du Canada*			Government of Canada accounts[2] *Comptes du gouvernement canadien*[2]			
					Treasury bills *Bons du Trésor*	Bonds *Obligations*	Total *Total*	Treasury bills *Bons du Trésor*	Bonds[3] *Obligations*[3]	Short-term instruments *Titres à court terme*	Total[3] *Total*[3]
	V37331		V37295	V37289	V37370	V37371	V37369	V37382	V37383	V37347	V37363
2016 O	143,700	533,505	5,363	682,568	18,075	77,666	95,741	-	-	-	-
N	142,400	535,232	5,182	682,814	16,675	77,524	94,199	-	-	-	-
D	137,100	539,921	5,134	682,155	15,325	78,694	94,018	-	-	-	-
2017 J	133,200	547,128	5,091	685,419	17,250	80,329	97,579	-	479	-	479
2017 J 4	134,500	539,739	5,126	679,365	16,825	78,694	95,519	-	-	-	-
11	131,700	539,083	5,119	675,902	16,825	78,694	95,519	-	-	-	-
18	130,400	542,694	5,107	678,201	17,275	79,279	96,554	-	-	-	-
25	131,900	544,913	5,098	681,911	17,275	79,849	97,124	-	-	-	-
F 1	133,200	546,689	5,091	684,980	17,250	76,909	94,159	-	-	-	-
Changes from the date indicated / *Variations par rapport à la date indiquée*											
2016 F 3	-12,200	43,096	-460	30,436	175	3,727	3,902	-	-459	-	-459
2017 J 25	1,300	1,776	-7	3,069	-25	-2,940	-2,965	-	-	-	-

End of period
En fin de période

GOVERNMENT OF CANADA SECURITIES OUTSTANDING (Par Value)
ENCOURS DES TITRES DU GOUVERNEMENT CANADIEN (Valeur nominale)

Millions of Canadian dollars
En millions de dollars canadiens

	Held by *Détenteurs*			
	General Public *Public*			
	Treasury bills *Bons du Trésor*	Marketable bonds and notes *Obligations et billets négociables*	Canada Savings Bonds and other retail instruments *Obligations d'épargne du Canada et autres titres de placement au détail*	Total *Total*
	V37377	V37378	V37295	V37375
2016 O	125,625	455,839	5,363	586,827
N	125,725	457,708	5,182	588,615
D	121,775	461,227	5,134	588,136
2017 J	115,950	466,320	5,091	587,361
2017 J 4	117,675	461,045	5,126	583,846
11	114,875	460,390	5,119	580,384
18	113,125	463,415	5,107	581,647
25	114,625	465,064	5,098	584,787
F 1	115,950	469,781	5,091	590,822
Changes from the date indicated / *Variations par rapport à la date indiquée*				
2016 F 3	-12,375	39,830	-460	26,995
2017 J 25	1,325	4,717	-7	6,035

Average of Wednesdays and Wednesday
Moyenne mensuelle des mercredis ou données du mercredi

GOVERNMENT OF CANADA CANADIAN DOLLAR DEPOSITS
DÉPÔTS EN DOLLARS CANADIENS DU GOUVERNEMENT CANADIEN

Millions of dollars
En millions de dollars

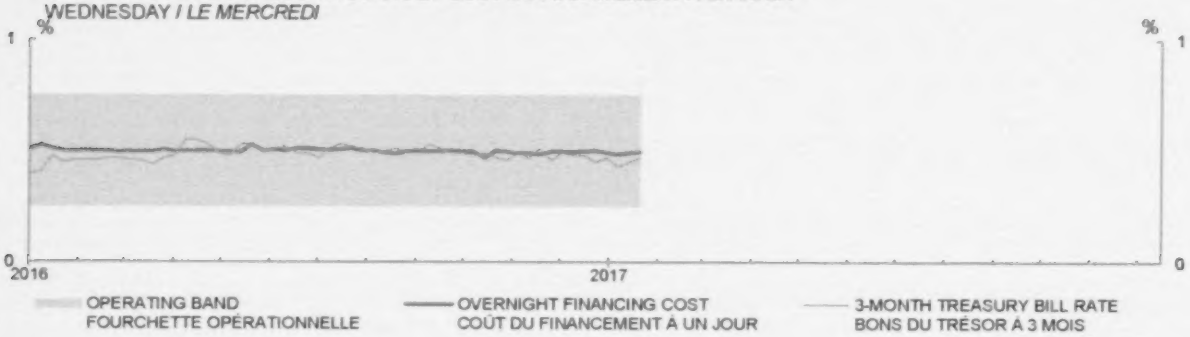
	Held at *Détenteurs*		
	Bank of Canada *Banque du Canada*	Auction Participants *Participants aux adjudications*	Total *Total*
	V36642	V37343	
	V36628		
2016 O	23,570	12,329	35,899
N	22,296	8,923	31,220
D	21,855	9,723	31,578
2017 J		11,517	
2017 J 4		8,290	
11		14,200	
18		11,879	
25		11,697	
F 1		5,588	
Changes from the date indicated / *Variations par rapport à la date indiquée*			
2016 F 3		-4,650	
2017 J 25		-6,109	

(1) Includes securities denominated in foreign currency (excluding U.S. -pay "Canada Bills"). *(Comprend les titres libellés en monnaies étrangères (à l'exclusion des « bons du Canada » en dollars É.-U.).*

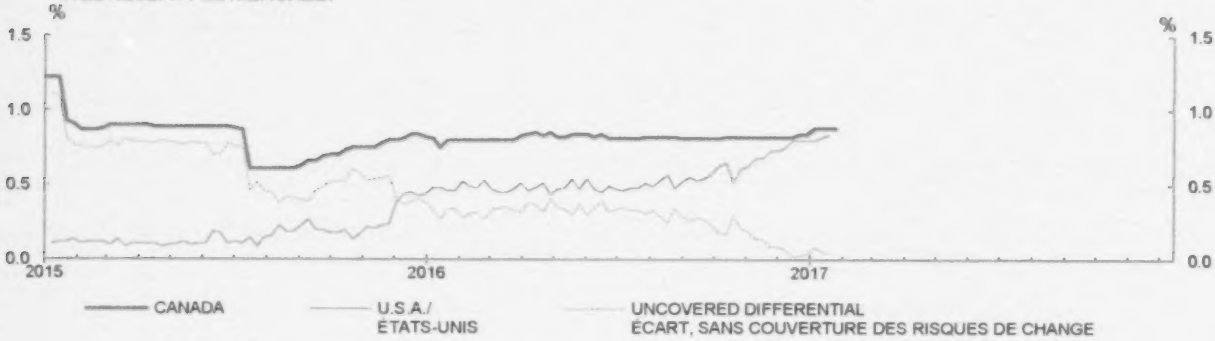
(2) Includes Government of Canada Accounts held at the Bank of Canada, plus non-market bonds held by the Canada Pension Plan. *(Comprend les comptes du gouvernement canadien à la Banque du Canada et les titres non négociables détenus par le Régime de pensions du Canada.*

(3) Effective September 2016, the composition for Government of Canada accounts held at the Bank of Canada no longer includes holdings of a government entity as these securities are not held by the Bank of Canada. *(À partir de septembre 2016, les comptes du gouvernement canadien tenus auprès de la Banque du Canada ne contiendront plus de titres d'entités publiques, puisque ces actifs ne sont pas détenus par la Banque.*

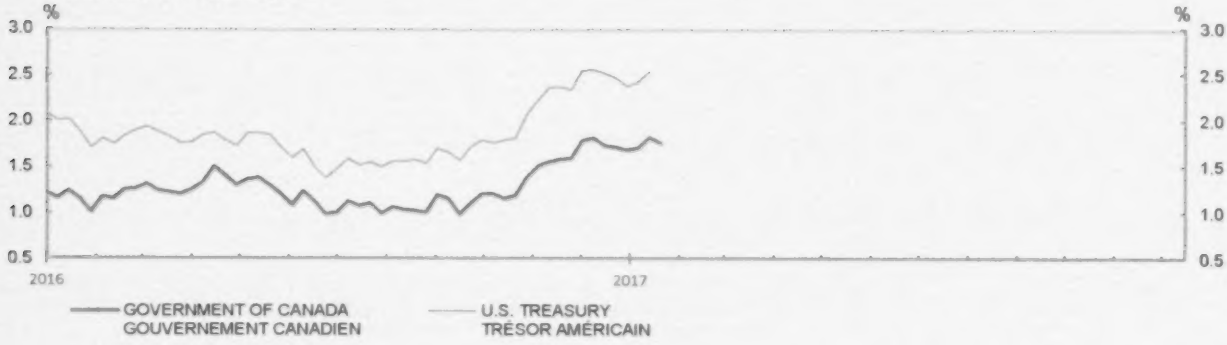
3-MONTH TREASURY BILL RATE AND OVERNIGHT FINANCING COST
TAUX DES BONS DU TRÉSOR À 3 MOIS ET COÛT DU FINANCEMENT À UN JOUR
WEDNESDAY / *LE MERCREDI*

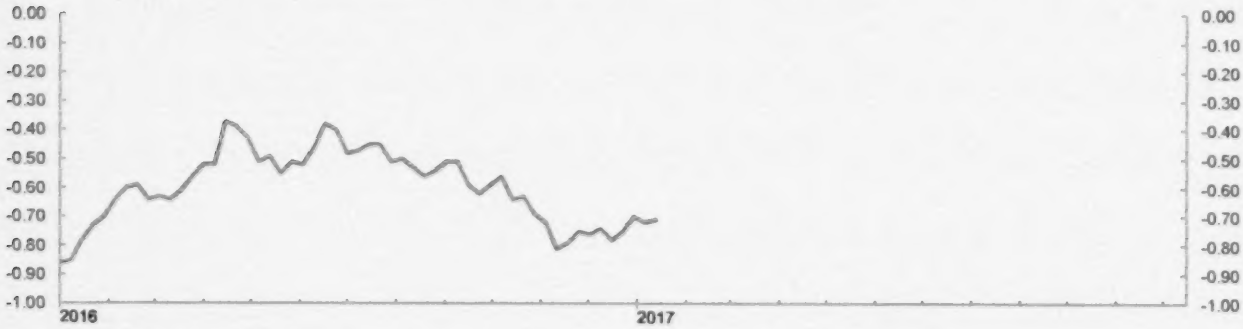


CANADA- U.S. 3-MONTH COMMERCIAL PAPER RATE
TAUX DU PAPIER COMMERCIAL À 3 MOIS – CANADA ET ÉTATS-UNIS
WEDNESDAY / *LE MERCREDI*



CANADA- U.S. GOVERNMENT 10 YEAR BOND YIELDS
OBLIGATIONS À 10 ANS DES GOUVERNEMENTS CANADIEN ET AMÉRICAIN
WEDNESDAY / *LE MERCREDI*

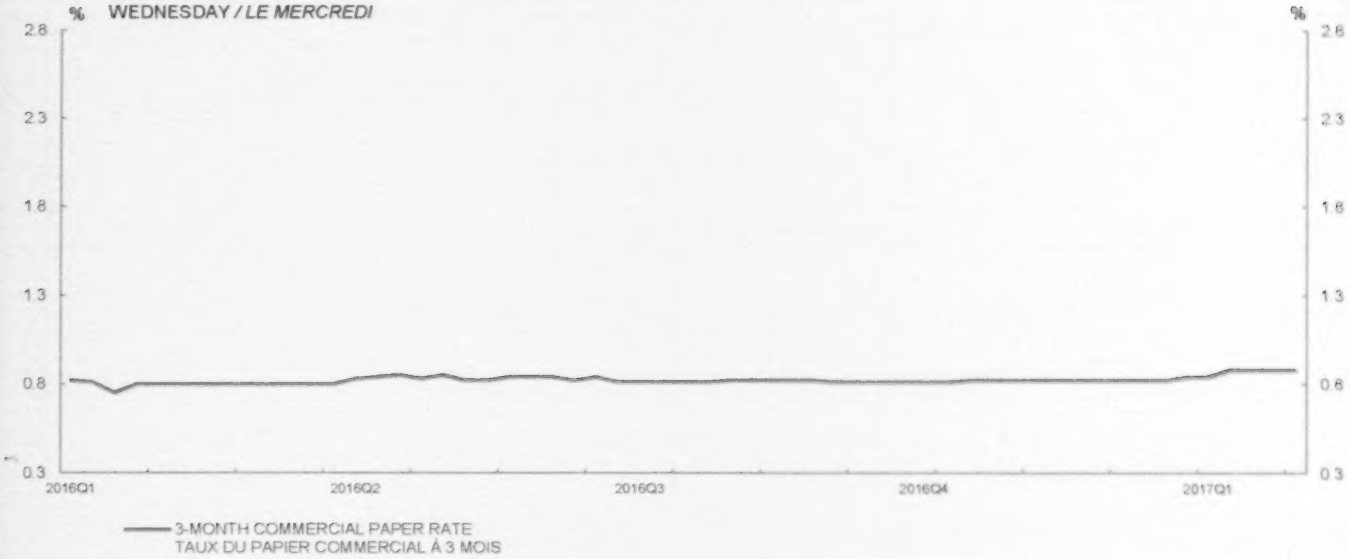




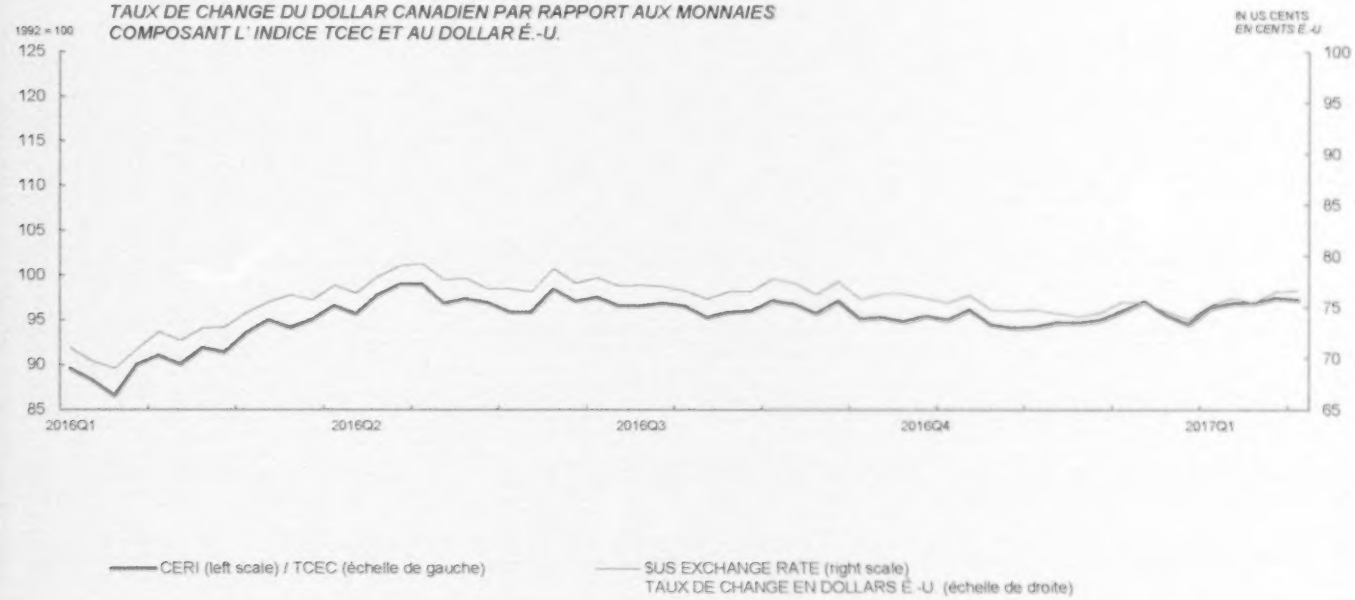
LAST DATA POINT PLOTTED (U.S. rates): 25-January-17
FIN DE LA PÉRIODE CONSIDÉRÉE (taux amér.) : 25-janvier-17

LAST DATA POINT PLOTTED (Cdn rates): 1-February-17
FIN DE LA PÉRIODE CONSIDÉRÉE (taux can.) : 1-février-17

MONETARY CONDITIONS INDICATORS / *INDICATEURS DES CONDITIONS MONÉTAIRES*
WEDNESDAY / *LE MERCREDI*

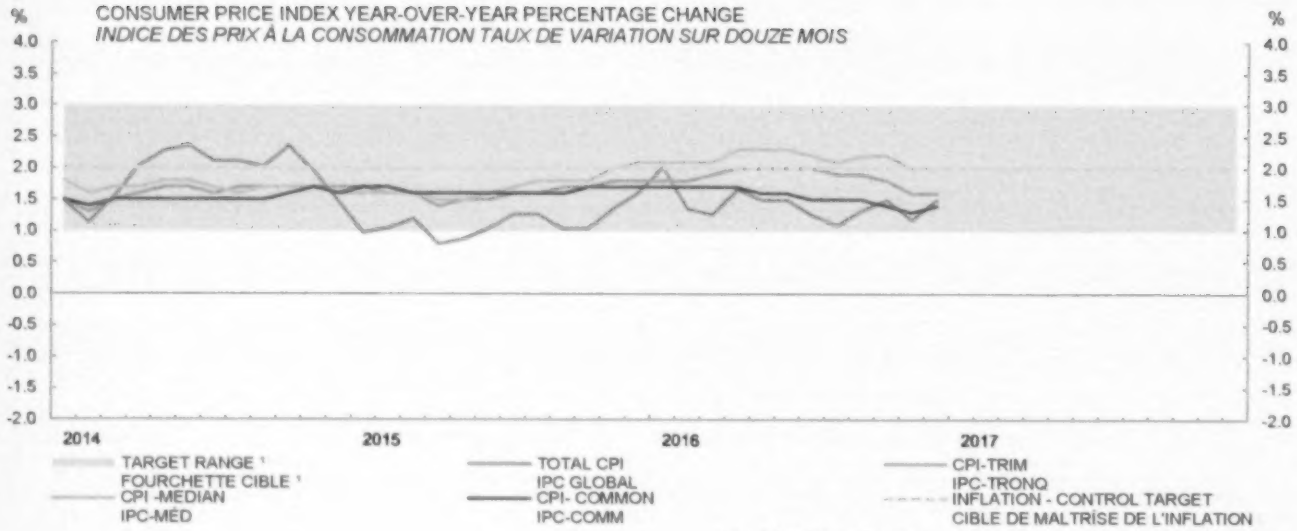


CERI EXCHANGE RATE INDEX AND $U.S. EXCHANGE RATE
TAUX DE CHANGE DU DOLLAR CANADIEN PAR RAPPORT AUX MONNAIES COMPOSANT L' INDICE TCEC ET AU DOLLAR É.-U.



LAST DATA POINT PLOTTED 1-Feb-17
FIN DE LA PÉRIODE CONSIDÉRÉE 1-fév-17

The Canadian-dollar effective exchange rate index (CERI) replaces the C-6 index as the Bank's new measure of the value of the Canadian dollar vis-à-vis the currencies of its most important trading partners. / *L'indice de taux de change effectif du dollar canadien (indice TCEC) s'agit du nouvel indice que la Banque utilise pour mesurer la valeur du dollar canadien par rapport aux monnaies des principaux partenaires commerciaux du Canada. L'indice TCEC remplace l'indice C-6.*



LAST DATA POINT PLOTTED: December 2016
FIN DE LA PÉRIODE CONSIDÉRÉE: décembre 2016

CONSUMER PRICE INDEX
INDICE DES PRIX À LA CONSOMMATION

Month / Mois	TOTAL CPI / *IPC GLOBAL*		Percentage (y/y) (not seasonally adjusted unless otherwise stated) / Taux de variation (a/a) (données non désaisonnalisées, sauf indication contraire)			
				Preferred measures of core inflation / Mesures privilégiées de l'inflation fondamentale		
				Seasonally adjusted / Données désaisonnalisées		
	Unadjusted / *Données non désaisonnalisées*	Seasonally adjusted / *Données désaisonnalisées*	TOTAL CPI / *IPC GLOBAL*	CPI-TRIM[2] / *IPC-TRONQ*[2]	CPI-MEDIAN[2] / *IPC-MÉD*[2]	CPI-COMMON[2] / IPC-COMM[2]
	V41690973	V41690914		V108785715	V108785714	V108785713
2015 M	126.9	126.3	0.9	1.5	1.5	1.6
J	127.2	126.8	1.0	1.5	1.6	1.6
J	127.3	127.0	1.3	1.6	1.7	1.6
A	127.3	127.0	1.3	1.6	1.8	1.6
S	127.1	126.9	1.0	1.7	1.8	1.6
O	127.2	127.1	1.0	1.7	1.8	1.7
N	127.1	127.3	1.4	1.8	2.0	1.7
D	126.5	127.4	1.6	1.8	2.1	1.7
2016 J	126.8	127.6	2.0	1.8	2.1	1.7
F	127.1	127.4	1.4	1.8	2.1	1.7
M	127.9	127.7	1.3	1.9	2.1	1.7
A	128.3	128.0	1.7	2.0	2.3	1.7
M	128.8	128.3	1.5	2.0	2.3	1.6
J	129.1	128.6	1.5	2.0	2.3	1.6
J	128.9	128.6	1.3	2.0	2.2	1.5
A	128.7	128.5	1.1	1.9	2.1	1.5
S	128.8	128.7	1.3	1.9	2.2	1.5
O	129.1	129.0	1.5	1.8	2.2	1.4
N	128.6	128.9	1.2	1.6	2.0	1.3
D	128.4	129.3	1.5	1.6	2.0	1.4

MONETARY CONDITIONS INDICATORS
INDICATEURS DES CONDITIONS MONÉTAIRES

Wednesday / Le mercredi	3-Month prime corporate paper rate / Taux du papier de premier choix des sociétés non financières à 3 mois	Canadian-dollar effective exchange rate index (CERI) / Indice de taux de change effectif du dollar canadien (indice TCEC)
	V121812	
2016 O 5	0.81	95.39
12	0.81	94.96
19	0.82	96.09
26	0.82	94.41
N 2	0.82	94.07
9	0.82	94.19
16	0.82	94.67
23	0.82	94.63
30	0.82	94.95
D 7	0.82	95.96
14	0.82	97.04
21	0.82	95.47
28	0.84	94.47
2017 J 4	0.84	96.32
11	0.88	96.81
18	0.88	96.84
25	0.88	97.43
F 1	0.88	97.22

CPI-TRIM: is a measure of core inflation that excludes CPI components whose rates of change in a given month are located in the tails of the distribution of price changes. / IPC-TRONQ est une mesure de l'inflation fondamentale qui exclut de l'IPC les composantes dont les taux de variation, au cours d'un mois donné, se situent dans les queues de distribution des variations de prix.

CPI-MEDIAN: is a measure of core inflation corresponding to the price change located at the 50th percentile (in terms of CPI basket weights) of the distribution of price changes in a given month. / IPC-MÉD est une mesure de l'inflation fondamentale qui correspond à la variation de prix se situant au 50e centile de la distribution des variations de prix au cours d'un mois donné, pondérées selon les poids des composantes dans le panier de l'IPC.

CPI-COMMON: is a measure of core inflation that tracks common price changes across categories in the CPI basket. / IPC-COMM est une mesure de l'inflation fondamentale qui extrait les mouvements communs des prix entre les catégories du panier de l'IPC.

(1) Although the target is expressed in terms of the total CPI, the Bank of Canada also uses for monetary policy purposes measures of core inflation such as CPI-TRIM, CPI-MEDIAN and CPI-COMMON. / Bien que la cible de maîtrise de l'inflation soit exprimée en fonction du taux d'accroissement de l'IPC global, la Banque du Canada utilise aussi, aux fins de la conduite de sa politique monétaire, des mesures de l'inflation fondamentale comme l'IPC-TRONQ, l'IPC-MÉD et l'IPC-COMM.

(2) Effective 23 December 2016, the core inflation (CPIX), CPIXFET, and CPIW are replaced by three new preferred measures of core inflation: CPI-TRIM, CPI-MEDIAN and CPI-COMMON respectively. / Le 23 décembre 2016, l'indice de référence (IPCX), l'IPCHAEI et l'IPCP seront remplacés par trois nouvelles mesures privilégiées de l'inflation fondamentale, soit, respectivement, l'IPC-TRONQ, l'IPC-MÉD et l'IPC-COMM.